建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优势动力混合（LOF）
场内简称	建信优势
基金主代码	165313
交易代码	165313
基金运作方式	上市契约型开放式（LOF）
基金合同生效日	2013年3月19日
报告期末基金份额总额	430,030,673.60份
投资目标	采取定量和定性相结合的方法，寻找具有良好内生性成长或外延式扩张动力、但是价值被低估的优势上市公司，通过对投资组合的动态调整来分散和控制风险，在注重基金资产安全的前提下有效利用基金资产来获取超额收益。
投资策略	本基金采取自上而下与自下而上相结合的投资策略。基金管理人对经济环境、市场状况、行业特性等宏观层面信息和个股、个券的微观层面信息进行综合分析，作出投资决策。
业绩比较基准	75%×沪深300指数收益率+25%×中国债券总指数收益率
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，其预期收益及预期风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金，属于中高收益/风险特征的基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	交通银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2015年10月1日 — 2015年12月31日）
1.本期已实现收益	90,170,166.31
2.本期利润	109,308,513.05
3.加权平均基金份额本期利润	0.2472
4.期末基金资产净值	647,516,384.81
5.期末基金份额净值	1.506

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

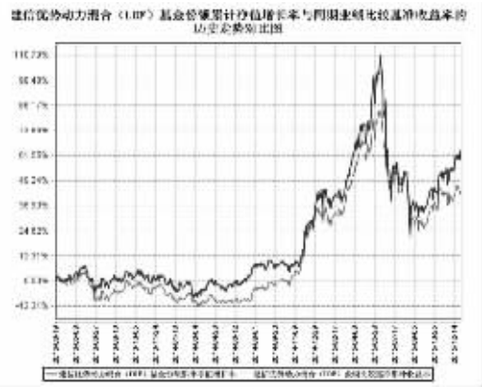
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	19.52%	1.39%	13.17%	1.25%	6.35%	0.14%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本基金于2013年3月19日进行转型，转型前为“建信优势动力股票型证券投资基金”。本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
姜锋	本基金的基金经理	2013年3月19日	－	8	硕士，2007年7月加入本公司，从事行业研究，任研究员。2011年7月11日至2013年3月18日任封闭式基金建信优势动力股票型证券投资基金基金经理，该基金于2013年3月19日起转换为开放式基金建信优势动力混合型证券投资基金（LOF），姜锋继续担任该基金基金经理；2014年3月21日起任建信健康民生混合型证券投资基金基金经理；2015年4月22日起任建信环保产业股票基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有1次，原因是投资组合投资策略需要，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度市场大幅反弹，各主要指数在经历了3季度的股灾后均出现不同程度的反弹，经济方面，国内经济继续下行，美国经济一枝独秀；政策方面，美国7年来首次加息，国内继续推行宽松的货币政策，人民币汇率波动幅度加大；上市公司方面，2015年3季报业绩平淡，年度业绩展望继续平淡。

本基金4季度基于对政策、经济基本面和企业盈利的判断，结合市场的估值水平，对行业进行了均衡配置，积极参与了TMT板块的反弹。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率19.52%，波动率1.39%，业绩比较基准收益率13.17%，波动率1.25%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，美国经济保持波动回升态势，2016年美联储加息次数将对全球经济和资本流动产生重要影响；欧洲经济步履蹒跚；国内经济在供给侧改革的引导下有望缓慢企稳，但人民币汇率的波动和需求的疲弱仍将限制经济复苏的步伐。2016年资本市场将迎来一系列新的制度、金融品类的多样化需要研究和评估。

本基金2016年1季度在控制系统性风险的前提下将采取相对均衡的配置策略，积极寻找受益于政策放松的低估值蓝筹行业和公司；本基金将继续在医药、环保、TMT和消费四大行业中自下而上寻找业绩增速与估值相匹配的优质成长股投资。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	481,233,646.41	73.47
	其中:股票	481,233,646.41	73.47
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	－	－
	其中:债券	－	－
	资产支持证券	－	－
4	贵金属投资	－	－
5	金融衍生品投资	－	－
6	买入返售金融资产	－	－
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	－
7	银行存款和结算备付金合计	129,724,344.08	19.80
8	其他资产	44,067,601.06	6.73
9	合计	655,025,591.55	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	50,340,843.42	7.77
B	采矿业	－	－
C	制造业	261,008,034.43	40.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,927,693.00	2.46
E	建筑业	26,993,467.20	4.17
F	批发和零售业	30,750,942.00	4.75
G	交通运输、仓储和邮政业	18,360,547.97	2.84
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,453,395.00	2.54
J	金融业	－	－
K	房地产业	18,794,769.00	2.90
L	租赁和商务服务业	25,935,314.04	4.01
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	16,668,640.35	2.57
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	－	－
R	文化、体育和娱乐业	－	－
S	综合	－	－
	合计	481,233,646.41	74.32

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000920	南方汇通	1,324,189	31,820,261.67	4.91
2	600351	亚宝药业	1,892,680	29,563,661.60	4.57
3	002308	威创股份	1,134,800	27,972,820.00	4.32
4	000705	浙江震元	1,464,800	27,479,648.00	4.24
5	002234	民和股份	1,526,469	27,445,912.62	4.24
6	601888	中国国旅	437,284	25,935,314.04	4.01
7	002630	华西能源	1,660,020	24,518,495.40	3.79
8	002236	大华股份	623,519	23,007,851.10	3.55
9	002458	益生股份	605,686	22,894,930.80	3.54
10	603001	奥康国际	668,352	22,469,994.24	3.47

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	655,156.34
2	应收证券清算款	43,354,732.39
3	应收股利	－
4	应收利息	56,810.84
5	应收申购款	901.49
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	44,067,601.06

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	453,200,628.47
报告期期间基金总申购份额	1,592,315.83
减:报告期期间基金总赎回份额	24,762,270.70
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	－
报告期期末基金份额总额	430,030,673.60

注:总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,591,235.63
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,591,235.63
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.84

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）设立的文件；

2、《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）基金合同》；

3、《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》；

4、《建信优势动力混合型证券投资基金（LOF）托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2016年1月21日

建信优化配置混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信优化配置混合
基金主代码	530005
交易代码	530005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年3月1日
报告期末基金份额总额	1,937,692,677.92份
投资目标	通过合理的资产配置和积极的证券选择，在实现长期资本增值的同时兼顾当期收益。
投资策略	基金管理人对宏观经济、行业及上市公司、债券、货币市场工具等进行定性与定量相结合的研究，运用自上而下和自下而上相结合的投资策略，在大类资产配置这一宏观层面与个股个券选择这一微观层面优化投资组合。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准:60%×富时中国A600指数+40%×中国债券总指数。
风险收益特征	本基金属于混合型证券投资基金，一般情况下其风险和收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

注:本基金自2015年8月8日起由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2015年10月1日 — 2015年12月31日）
1.本期已实现收益	181,110,650.61
2.本期利润	493,164,083.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.2485
4.期末基金资产净值	2,892,461,724.59
5.期末基金份额净值	1.4927

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	19.57%	1.71%	11.68%	1.01%	7.89%	0.70%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:本报告期,本基金投资比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱宇航	本基金的基金经理	2015年5月20日	－	8	硕士,2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理,基金经理。2011年7月11日至2014年3月27日任建信恒久价值混合型证券投资基金基金经理;2013年6月14日起任建信消费升级混合型证券投资基金基金经理;2015年5月20日起任建信优化配置混合基金基金经理。
陶灿	本基金的基金经理	2011年7月11日	－	8	硕士,2007年7月加入本公司,从事行业研究,历任研究员、基金经理助理。2011年7月11日起任建信优化配置混合型证券投资基金基金经理;2014年5月14日起任建信改革红利股票型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内,基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益,严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人,保护投资人利益,避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为,公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度,制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块,一旦出现不同基金同时买卖同一证券时,系统自动切换至公平交易模块进行操作,确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况有1次,原因是投资组合投资策略需要,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年4季度,A股在经历了前期下跌后,市场出现了企稳并恢复上涨的局面;一方面随着汇金、证金入场,限制上市公司高管减持等措施的推出,市场供求格局好转,另一方面融资杠杆逐步降低释放了市场压力。

本基金4季度跟随市场市局新的投资方向,但也慎重应对市场再次泡沫化所可能产生的风险。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期基金净值增长率19.57%,波动率1.71%,业绩比较基准收益率11.68%,波动率1.01%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望1季度,人民币汇率问题带来资本流出预期;供给侧改革任务比较艰巨;市场对于注册制的反应也值得关注;但注册制后市场估值体系调整会带来新的机会,市场的内部结构调整会孕育新的方向。

本基金在1季度将注意市场风险释放,更加重视个股的增长质量,布局重点仍放在各细分领域的龙头个股。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	2,138,885,870.85	72.98
	其中:股票	2,138,885,870.85	72.98
2	基金投资	－	－
3	固定收益投资	－	－
	其中:债券	－	－
	资产支持证券	－	－
4	贵金属投资	－	－
5	金融衍生品投资	－	－
6	买入返售金融资产	－	－
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	－	－
7	银行存款和结算备付金合计	768,169,316.51	26.21
8	其他资产	23,891,247.73	0.82
9	合计	2,930,946,435.09	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	45,971,908.00	1.59
B	采矿业	37,796,117.27	1.31
C	制造业	1,067,256,837.54	36.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	132,994,232.57	4.60
E	建筑业	42,060,256.43	1.45
F	批发和零售业	83,124,231.00	2.87
G	交通运输、仓储和邮政业	215,015,987.24	7.43
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	312,967,251.08	10.82
J	金融业	67,397,898.58	2.33
K	房地产业	68,260,773.77	2.36
L	租赁和商务服务业	27,436,772.88	0.95
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	－	－
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	－	－
R	文化、体育和娱乐业	38,494,212.28	1.33
S	综合	－	－
	合计	2,138,885,870.85	73.95

注:以上行业分类以2015年12月31日的中国证监会行业分类标准为依据。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600271	航天信息	2,923,161	208,889,085.06	7.22
2	300017	网宿科技	1,720,741	103,227,252.59	3.57
3	600718	东软集团	2,370,944	73,617,811.20	2.55
4	601998	中信银行	9,334,889	67,397,898.58	2.33
5	002308	威创股份	2,581,300	63,629,045.00	2.20
6	600570	恒生电子	904,254	55,132,366.38	1.91
7	600651	飞乐音响	3,295,986	48,615,793.50	1.68
8	300357	我武生物	903,566	45,810,796.20	1.58
9	000680	山推股份	5,814,800	44,483,220.00	1.54
10	002137	麦达数字	1,814,762	41,739,526.00	1.44

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金报告期内未投资于国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金该报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的投资范围。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,909,420.58
2	应收证券清算款	21,723,541.81
3	应收股利	－
4	应收利息	130,414.55
5	应收申购款	127,870.79
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	23,891,247.73

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600271	航天信息	208,889,085.06	7.22	重大资产重组

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	2,031,083,258.10
报告期期间基金总申购份额	25,194,809.71
减:报告期期间基金总赎回份额	118,585,389.89
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	－
报告期期末基金份额总额	1,937,692,677.92

注:上述总申购份额含红利再投资和转换转入份额,总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	3,354,285.54
报告期期间买入/申购总份额	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	3,354,285.54
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	0.17

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末发生管理人运用固有资金投资本基金的情况。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准建信优化配置混合型证券投资基金设立的文件；

2、《建信优化配置混合型证券投资基金基金合同》；

3、《建信优化配置混合型证券投资基金招募说明书》；

4、《建信优化配置混合型证券投资基金托管协议》；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

8.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后,在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司
2016年1月21日

建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:建信基金管理有限责任公司
基金托管人:交通银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月21日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	建信央视50		
场内简称	建信50		
基金主代码	165312		
交易代码	165312		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2013年3月28日		
报告期末基金份额总额	447,531,154.72份		
投资目标	本基金采取指数化投资方式，通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段，力争实现跟踪偏离度和跟踪误差最小化，实现对央视财经50指数的有效跟踪。		
投资策略	本基金采用被动式指数化投资策略。原则上股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合、复制标的指数，并原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。 本基金对标的指数的跟踪目标：力争使得日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。		
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准：95%×央视50价格指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。		
风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。 从本基金所分离的两类基金份额来看，建信央视50A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额；建信央视50B份额则表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。		
基金管理人	建信基金管理有限责任公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
下属分级基金简称	建信央视50	建信央视50A	建信央视50B
下属分级场内简称	建信50	建信50A	建信50B
下属分级基金交易代码	165312	150123	150124
下属分级基金报告期末基金份额总额	42,744,040.72份	202,393,557.00份	202,393,557.00份
下属分级基金的风险收益特征	本基金属于采用指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。	建信央视50A份额将表现出低风险、收益相对稳定的特征，其预期收益和预期风险要低于普通的股票型基金份额。	建信央视50B份额将表现出高风险、高收益的显著特征，其预期收益和预期风险要高于普通的股票型基金份额。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期（2015年10月1日 — 2015年12月31日）
1.本期已实现收益	15,255,341.48
2.本期利润	112,086,227.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.2196
4.期末基金资产净值	620,995,438.99
5.期末基金份额净值	1.3876

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动损益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动损益。

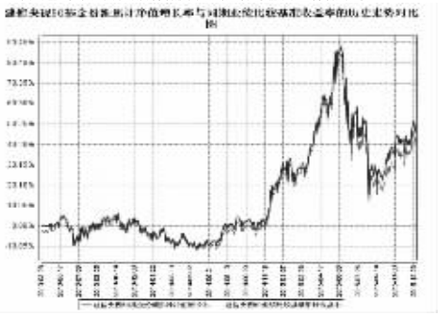
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	18.94%	1.52%	19.84%	1.46%	－0.90%	0.06%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:本报告期,本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
叶乐天	本基金的基金经理	2013年3月28日	－	7	硕士。曾就职于中国国际金融有限公司，先后担任市场风险管理分析员、量化分析经理、从事风险模型、量化研究与投资；2011年9月加入我公司,担任基金经理助理。2012年3月21日起任上证社会责任交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理；2013年3月28日起任建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金的基金经理；2014年1月27日起任中证500指数增强基金经理；2015年8月26日起任建信精工制造指数增强型证券投资基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、其他有关法律法规的规定和《建信央视财经50指数分级发起式证券投资基金基金合同》的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金管理人所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较